

DAFTAR ISI

PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	iii
ABSTRAK.....	iv
ABSTRACT.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR SINGKATAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Identifikasi Masalah.....	7
1.3 Tujuan Penelitian.....	7
1.4 Kegunaan penelitian.....	8
1.4.1 Lokasi Penelitian.....	8
1.4.2 Jadwal Penelitian.....	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LANDASAN TEORI.....	10
2.1 Tinjauan Pustaka.....	10
2.1.1 <i>Return Saham</i>	10
2.1.2 <i>Macam-macam return saham</i>	11
2.1.3 <i>Signalling Theory</i>	12
2.1.4 <i>Faktor-faktor yang Mempengaruhi Return Saham</i>	12
2.1.4.1 <i>Return on Equity (ROE)</i>	13
2.1.4.2 <i>Current Ratio (CR)</i>	14
2.1.4.3 <i>Total Asset Turnover (TATO)</i>	15
2.1.4.4 <i>Tingkat Inflasi</i>	15
2.1.4.5 <i>Nilai Kurs Rupiah</i>	16
2.2 Penelitian Terdahulu.....	17
2.3 Kerangka Pemikiran.....	22

2.3.1 Hubungan <i>Return On Equity</i> dengan <i>Return Saham</i>	22
2.3.2 Hubungan <i>Current Ratio</i> dengan <i>Return Saham</i>	23
2.3.3 Hubungan <i>Total Asset Turnover</i> dengan <i>Return Saham</i>	24
2.3.4 Hubungan Inflasi dengan <i>Return Saham</i>	25
2.3.5 Hubungan Nilai Kurs Rupiah dengan <i>Return Saham</i>	26
2.4 Hipotesis	28
BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN	30
3.1 Objek Penelitian	30
3.2 Metode Penelitian	30
3.2.1 Operasionalisasi Variabel.....	30
3.2.2 Teknik Pengumpulan Data.....	32
3.2.3 Jenis Data.....	33
3.2.3.1 Populasi Saran.....	33
3.2.3.2 Penentuan Sampel.....	33
3.2.3.3 Prosedur Pengumpulan Data.....	36
3.3 Model Penelitian	37
3.4 Teknik Analisis Data	38
3.4.1 Analisis Regresi Data Panel.....	38
3.4.2 Pemilihan Modal Data Panel.....	39
3.4.3 Uji Asumsi Klasik.....	41
3.4.3.1 Uji Normalitas.....	41
3.4.3.2 Uji Multikolinearitas.....	41
3.4.3.3 Uji Heteroskedastisitas.....	42
3.4.4 Uji Hipotesis.....	43
3.4.4.1 Uji Signifikansi Parameter (Uji t).....	43
3.4.4.1 Uji Signifikansi Bersama-sama (Uji F).....	44
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	46
4.1 Hasil Penelitian	46
4.1.1 Deskripsi Data Penelitian.....	46
4.1.1.1 <i>Return on Equity</i> pada perusahaan perbankan.....	46
4.1.1.2 <i>Current Ratio</i> pada perusahaan perbankan.....	47
4.1.1.3 <i>Total Asset Turnover</i> pada perusahaan perbankan.....	48

4.1.1.4 Tingkat inflasi Indonesia tahun 2019-2023.....	50
4.1.1.5 Nilai kurs Indonesia tahun 2019-2023	50
4.1.2 Uji pemilihan Model Regresi Data Panel.....	51
4.1.3 Uji Normalitas	52
4.1.4 Uji Asumsi Klasik.....	53
4.1.5 Hasil Analisis Modal Regresi Data Panel	54
4.2 Pembahasan.....	55
4.2.1 <i>Return on Equity</i> (ROE) pada perusahaan sektor perbankan di BEI tahun 2019-2023	55
4.2.2 <i>Current Ratio</i> (CR) pada perusahaan sektor perbankan di BEI tahun 2019-2023	57
4.2.2 <i>Total Asset Turnover</i> (TATO) pada perusahaan sektor perbankan di BEI tahun 2019-2023	59
4.2.3 Tingkat Inflasi Indonesia pada tahun 2019-2023 60	
4.2.4 Nilai kurs rupiah terhadap US dolar pada tahun 2019-2023 61	
4.3 Pengaruh <i>Return On Equity</i>, <i>Current Ratio</i>, <i>Total Asset Turnover</i>, Inflasi dan Nilai Kurs Terhadap <i>Return Saham</i> secara bersama – sama pada Perusahaan Perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2019-2023	62
4.3.1 Pengaruh <i>Return on Equity</i> terhadap <i>Return Saham</i> secara parsial pada Perusahaan Perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2019-2023	64
4.3.2 Pengaruh <i>Current Ratio</i> terhadap <i>Return Saham</i> secara parsial pada Perusahaan yang terdaftar di Busra Efek Indonesia pada tahun 2019-2023	65
4.3.3 Pengaruh <i>Total Asset Turnover</i> terhadap <i>Return Saham</i> secara parsial pada Perusahaan yang terdaftar di Busra Efek Indonesia pada tahun 2019-2023	66
4.3.4 Pengaruh Inflasi terhadap <i>Return Saham</i> secara parsial pada Perusahaan yang terdaftar di Busra Efek Indonesia pada tahun 2019-2023.....	67
4.3.5 Pengaruh Nilai Kurs terhadap <i>Return Saham</i> secara parsial pada Perusahaan Perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2019-2023.....	68
BAB V SIMPULAN DAN SARAN.....	69
5.1 Simpulan.....	69
5.2 Saran	71
DAFTAR PUSTAKA.....	73
LAMPIRAN.....	76

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Jadwal Penelitian.....	9
Tabel 2.1 Penelitian Terdahulu.....	17
Tabel 3.1 Operasionalisasi Variabel.....	31
Tabel 3.2 Proses Pemilihan Sampel Perusahaan Perbankan.....	35
Tabel 3.3 Daftar Sampel Perusahaan Perbankan.....	36
Tabel 1.3 Daftar Sampel Perusahaan Perbankan.....	36
Tabel 4.1 <i>Return On Equity</i> Perusahaan Perbankan (BEI) Tahun 2019-2023.....	47
Tabel 4.2 <i>Current Ratio</i> Perusahaan Perbankan (BEI) Tahun 2019-2023.....	48
Tabel 4.3 <i>Total Asset Turnover</i> Perusahaan Perbankan (BEI) Tahun 2019-2023.....	49
Tabel 4.4 Tingkat Inflasi Indonesia Tahun 2019-2023.....	50
Tabel 4.5 Nilai kurs Rupiah terhadap USD Tahun 2019-2023.....	51
Tabel 4.6 Uji Chow.....	51
Tabel 4.7 Uji Hausman.....	52
Tabel 4.8 Uji Heteroskedastisitas.....	53
Tabel 4.9 Uji Multikolinearitas.....	53
Tabel 4.10 Hasil <i>Fixed Effect Model</i> Regresi Data Panel.....	54

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Tingkat <i>Return</i> Perusahaan Perbankan Tahun 2019-2023.....	2
Gambar 1.2 <i>Return On Equity</i> Bank BCA Tahun 2019-2023.....	3
Gambar 1.3 <i>Current Ratio</i> Bank BCA Tahun 2019-2023.....	4
Gambar 1.4 <i>Total Asset Turnover</i> Bank BCA Tahun 2019-2023.....	4
Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran.....	28
Gambar 4.1 Uji Normalitas.....	52
Gambar 4.2 Rata-rata ROE Perusahaan Perbankan Tahun 2019-2023	56
Gambar 4.3 Rata-rata CR Perusahaan Perbankan Tahun 2019-2023.....	58
Gambar 4.4 Rata-rata TATO Perusahaan Perbankan Tahun 2019-2023.....	60
Gambar 4.5 Tingkat Inflasi Indonesia Tahun 2019-2023.....	61
Gambar 4.6 Nilai Kurs Rupiah terhadap Dolar US Tahun 2019-2023.....	62

DAFTAR SINGKATAN

Nomor	Singkatan	Istilah
1	ROE	<i>Return On Equity</i>
2	CR	<i>Current Ratio</i>
3	TATO	<i>Total Asset Turnover</i>